

**RESUMO DOS INVESTIMENTOS
PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO**

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.01.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			2.880.039.224,61		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			1.977.640.081,16	68,67	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL</u>					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		358.485	1.266.925.593	43,99	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			616.260.206,36	21,40	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		5.002,00	10.565.830,62	0,37	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	44.627.825,93	1,55	1,55
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.453.009,07	0,19	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.431.276,56	0,19	0,38
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	5.000	10.565.830,62	0,37	0,37
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-44.627.825,93	-1,55	-1,55
- BANCO MORADA		-3	-10.884.285,63	-0,38	-0,38
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		357	111.784.331,15	3,88	
. ABC		21	11.755.615	0,41	0,41
. PARANÁ BANCO		160	37.854.440,28	1,31	1,31
. BRADESCO		176	58.621.425,96	2,04	2,04
. BANCO BTG PACTUAL		0	0,00	0,00	0,00
. SAFRA		4	3.552.850,07	0,12	0,12
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		237.752.235,15	493.910.044,59	17,15	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	61.943,83	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		23.905.571,88	42.501.321,75	1,48	1,48
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		33.448.365,49	103.732.365,63	3,60	3,60
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		16.633.381,77	50.884.691,42	1,77	1,77
. AF GERAES 30		10.071.484,93	11.473.711,59	0,40	0,40
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	14.287,15	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		6.891.627,03	20.750.414,04	0,72	0,72
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.708.925,00	350,48	0,00	0,00
. CA AG VITESSE		491.451,18	11.299.504,56	0,39	0,39
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		60.429.535,15	77.463.491,68	2,69	2,69
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		64.441,08	29.428.042,81	1,02	1,02
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	8.440.138,23	0,29	0,29
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		78.649,64	7.973.993,51	0,28	0,28
. AZ QUEST LUCE		71.479.748,26	103.784.371,46	3,60	3,60
. ARX VINSON FI RF CP		10.431.101,69	11.445.870,25	0,40	0,40
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	240.169,05	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	70.063,57	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	34.634,00	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.821.651,98	0,06	0,06
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		9.824,52	12.489.027,60	0,43	0,43
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		52.071	83.587.927,89	2,91	
. CEMIG		32.000	49.372.420,43	1,71	1,71
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		1.949	736.964,74	0,03	0,03
. LOJAS AMERICANAS		720	9.491.904,67	0,33	0,33
. ECOPISTAS		7.000	6.105.489,40	0,21	0,21
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	9.508.715,73	0,33	0,33
. SABESP		1.265	6.946.792,41	0,24	0,24
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		345	1.425.640,51	0,05	0,05
. VALORES A RECEBER					
. COMANCHE PART.			9.349.383,12	0,32	0,32
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS					
. COMANCHE PART.			-9.349.383,12	-0,32	-0,32

**RESUMO DOS INVESTIMENTOS
PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO**

CONSOLIDADO

Outros Títulos		7	10.866.354,18	0,38	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.158.576,26	0,53	0,53
. VALORES A RECEBER			3.274.905,95	0,11	0,11
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-7.567.128,03	-0,26	-0,26
B - INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			295.395.848,57	10,26	
B1. Mercado de Ações			75.773.864,34	2,63	
Companhias Abertas		1.946.641	60.086.018,03	2,09	
. AMBEV	ON	120.607	2.152.834,95	0,07	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	86.578	2.644.957,90	0,09	
. COSAN	ON	64.800	5.164.560,00	0,18	
. ECORODOVIAS	ON	149.200	2.645.316,00	0,09	
. GERDAU - GGBR	PN	147.388	2.955.129,40	0,10	
. ITAUSA	ON	216	2.833,92	0,00	
. ITAUSA	PN	491.509	6.320.805,74	0,22	
. LOGG COMERCIAL	ON	7.386	233.398	0,01	
. MRVE	ON	104.800	2.187.176,00	0,08	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	64.000	5.445.120,00	0,19	
. PETROBRÁS	PN	258.894	7.365.534,30	0,26	
. RENT	ON	189.378	10.156.342,14	0,35	
. SUZANO PAPEL	PNA	82.100	3.256.907,00	0,11	
. VALE R. DOCE	PNA	179.785	9.037.791,95	0,31	
. VIVT - TELEF. BRASIL	PN	0	-	0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			517.311,13	0,02	
Instituições Financeiras		493.412	15.687.846,31	0,54	
. BRADESCO	PN	239.641	7.341.508,46	0,25	
. ITAU	PN	253.771	8.328.764,22	0,29	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			17.573,63	0,00	
B2. Fundos		49.522.521,13	219.621.984,23	7,63	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	24.278.123,24	0,84	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	48.374.299,89	1,68	
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	27.721.429,81	0,96	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	22.369.158,72	0,78	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	17.056.205,32	0,59	
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	39.913.757,54	1,39	
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	39.909.009,71	1,39	
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		96.487.754	283.809.042,31	9,85	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-111.239,79	0,00	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.506,93	2.253.812,81	0,08	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	27.376.177,61	0,95	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.220,00	17.322.369,06	0,60	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA		5.000,00	5.038.008,72	0,17	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.066,22	6.161.302,93	0,21	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.876.004,07	1.628.573,41	0,06	
. HAMILTON LANE FIC FIP		19.700,40	32.562.243,06	1,13	
. MULTINER FIP		10,17	-7.967,82	0,00	
. STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	14.524.780,00	0,50	
. P2BR INFR III FIQFIP		9.848,00	22.374.050,22	0,78	
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	6.653.184,60	0,23	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		9.097.590,07	19.242.653,91	0,67	
. KINEA CHRONOS FIM		19.486.337,47	35.243.058,15	1,22	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		15.860.872,32	25.931.347,18	0,90	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		29.971.798,56	34.096.832,19	1,18	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		121.264,39	33.519.856,11	1,16	
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		41.269.530	117.007.850,83	4,06	
. BB MM SCH INV EXTE FI		9.648.030,71	29.045.241,12	1,01	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		6.648.054,77	22.198.505,52	0,77	
. VOT ALLIANZGI FIM		7.605.013,33	18.883.215,77	0,66	
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		6.931,42	11.746.867,64	0,41	
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		92.862,26	12.143.538,36	0,42	
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		7.403.274,30	11.847.680,92	0,41	
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		9.865.363,24	11.142.801,50	0,39	

**RESUMO DOS INVESTIMENTOS
PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO**

CONSOLIDADO

E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			117.525.413,51	4,08
E1 - Investimentos em Shopping Center			61.510.735,31	2,14
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			37.113.783,24	1,29
. SHOPPING PLAZA SUL			0,00	0,00
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			24.381.227,74	0,85
. VALORES A RECEBER			15.724,33	0,00
E2 - Investimento Imobiliário			8.939.494,85	0,31
. PANAMBY			8.939.494,85	0,31
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário				
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	250.344,45		41.673.460,68	1,45
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	99.010,00		11.382.189,60	0,40
. GGR COVEPI RENDA FII	784,45		9.203.990,48	0,32
. VALORES A RECEBER	150.550,00		21.031.835,00	0,73
. VALORES A PAGAR			55.445,60	0,00
			0,00	0,00
E3 - Outros Investimentos Imobiliário			44	0,19
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS	44		5.401.722,67	0,19
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		4.056	87.514.478,41	3,04
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		4.056	84.031.486,69	2,92
. VALORES A PAGAR (-)			-40.013,65	0,00
. VALORES A RECEBER			3.523.005,37	0,12
G - OUTROS			1.146.509,82	0,04
. DISPONIVEL			1.519.094,52	0,05
. DEPOSITOS JUDICIAIS			1.639.696,75	0,06
. OUTROS REALIZAVEIS			3.466.358,06	0,12
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			0,00	0,00
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.104.965,27	-0,18
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-373.674,24	-0,01

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS			
- SANT FIC FI ISN RF D	61.943,83	0,01%	0,00%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	350,48	0,00%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	42.501.321,75	3,68%	1,48%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES	103.732.365,63	8,97%	3,60%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP	50.884.691,42	4,40%	1,77%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	24.278.123,24	2,10%	0,84%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	48.374.299,89	4,18%	1,68%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	17.056.205,32	1,48%	0,59%
- MOAT CAPITAL FIA	39.913.757,54	3,45%	1,39%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	29.428.042,81	2,55%	1,02%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	8.440.138,23	0,73%	0,29%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II	7.973.993,51	0,69%	0,28%
- SPX APACHE FIA	39.909.009,71	3,45%	1,39%
- CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP	11.299.504,56	0,98%	0,39%
- IBIUNA EQ. FIC FIA	22.369.158,72	1,94%	0,78%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	240.169,05	0,02%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	70.063,57	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	34.634,00	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.	1.821.651,98	0,16%	0,06%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	12.489.027,60	1,08%	0,43%
- SAN FC EXTRA RF REF	14.287,15	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	20.750.414,04	1,79%	0,72%
- BBM SMID CAPS FICFIA	27.721.429,81	2,40%	0,96%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES 30	11.473.711,59	0,99%	0,40%
- AZ QUEST LUCE	103.784.371,46	8,98%	3,60%
- ARX VINSON FI RF CP	11.445.870,25	0,99%	0,40%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM	77.463.491,68	6,70%	2,69%
- VINCI VALOREM FIM	-	0,00%	0,00%
- BRAD RF DI FED EXTRA	-	0,00%	0,00%

**RESUMO DOS INVESTIMENTOS
PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO**

CONSOLIDADO

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(111.239,79)	-0,01%	0,00%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			2.253.812,81	0,19%	0,08%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			27.376.177,61	2,37%	0,95%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			17.322.369,06	1,50%	0,60%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA			5.038.008,72	0,44%	0,17%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			6.161.302,93	0,53%	0,21%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			1.628.573,41	0,14%	0,06%
- HAMILTON LANE FIC FIP			32.562.243,06	2,82%	1,13%
- MULTINER FIP			-7.967,82	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			14.524.780,00	1,26%	0,50%
- P2BR INFR III FIQFIP			22.374.050,22	1,94%	0,78%
- COPA FLORESTAL III			6.653.184,60	0,58%	0,23%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			19.242.653,91	1,66%	0,67%
- KINEA CHRONOS FIM			35.243.058,15	3,05%	1,22%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			25.931.347,18	2,24%	0,90%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			34.096.832,19	2,95%	1,18%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			33.519.856,11	2,90%	1,16%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			11.437.635,20	0,99%	0,40%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			9.203.990,48	0,80%	0,32%
- GGR COVEPI RENDA FII			21.031.835,00	1,82%	0,73%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			29.045.241,12	2,51%	1,01%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			22.198.505,52	1,92%	0,77%
- VOT ALLIANZGI FIM			18.883.215,77	1,63%	0,66%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			11.746.867,64	1,02%	0,41%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			12.143.538,36	1,05%	0,42%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			11.847.680,92	1,02%	0,41%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			11.142.801,50	0,96%	0,39%
TOTAL			1.156.022.382,68	100,00%	40,14%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA			1.483.730.036,57	86,06%	51,52%
RENDA VARIÁVEL			75.773.864,34	4,40%	2,63%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			75.851.952,83	4,40%	2,63%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			87.514.478,41	5,08%	3,04%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			1.146.509,82	0,07%	0,04%
TOTAL			1.724.016.841,97	100,00%	59,86%